

DAFTAR ISI

	Halaman
PERNYATAAN	
UCAPAN TERIMA KASIH	i
ABSTRAK	iii
ABSTRACT	iv
DAFTAR ISI.....	v
DAFTAR TABEL	vii
DAFTAR LAMPIRAN	viii
BAB I PENDAHULUAN	
1.1 Latar Belakang Masalah.....	1
1.2 Rumusan Masalah	3
1.3 Batasan Masalah	3
1.4 Tujuan Penulisan.....	4
1.5 Manfaat Penulisan.....	4
BAB II LANDASAN TEORITIS	
2.1 Investasi	5
2.2 Pasar Modal	5
2.3 Saham	7
2.3.1. Jenis-jenis saham.....	7
2.3.2. Indeks Harga Saham	8
2.3.3. <i>Return</i> pada Saham	8
2.4 Bank.....	9
2.5 <i>Risk Management</i>	10
2.6 Fungsi Distribusi.....	11
2.7 Momen.....	12
2.8 Peluang	13
2.10. Proses Stokastik.....	14
2.11. Matriks.....	14
2.12. Ruang Vektor.....	16

BAB III METODE PENELITIAN

3.1 <i>Value at Risk</i>	18
3.1.1. Pendekatan Distribusi Normal (Varians-Covarians).....	19
3.1.2. Pendekatan Ekspansi Cornish Fisher	21
3.2 Rantai Markov	23
3.3 Prosedur Metode VaR dengan Menggunakan Pendekatan Cornish Fisher dan Metode Rantai Markov.....	35

BAB IV STUDI KASUS

4.1 Sumber Data.....	37
4.2 Analisis Model Menggunakan Metode Value at Risk dengan Pendekatan Cornish Fisher	37
4.2.1. Variabel penelitian pada metode <i>Value at Risk</i> dengan pendekatan Cornish Fisher	37
4.2.2. Analisa perhitungan pada instrumen saham	38
4.3 Analisis Model Menggunakan Metode Rantai Markov	44
4.3.1. Variabel penelitian pada metode rantai Markov	44
4.3.2. Analisa perhitungan pada instrumen saham	44
4.4 Hasil Analisis Menggunakan Metode Value at Risk dengan Pendekatan Cornish Fisher dan Metode Rantai Markov	53

BAB V SIMPULAN, IMPLIKASI DAN REKOMENDASI

5.1. Kesimpulan	54
5.2. Saran	55

DAFTAR PUSTAKA

LAMPIRAN.....

RIWAYAT HIDUP